

**Aviso:** [2026-05-10 17:56] este documento é uma impressão do portal Ciência\_Iscte e foi gerado na data indicada. O documento tem um propósito meramente informativo e representa a informação contida no portal Ciência\_Iscte nessa data.

## João Pedro Vidal Nunes

### Professor Catedrático

BRU-Iscte - Business Research Unit  
Departamento de Finanças (IBS)



### Contactos

<b>E-mail</b>	joao.nunes@iscte-iul.pt
<b>Gabinete</b>	D5.31
<b>Telefone</b>	217650526 (Ext: 220151)
<b>Cacifo</b>	103-A

### Qualificações Académicas

Universidade/Instituição	Tipo	Curso	Período
University of Warwick	Doutoramento	Gestão	2000
Instituto Superior de Economia e Gestão - UTL	Mestrado	Economia	1994
ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	Licenciatura	Organização e Gestão de Empresas	1990

### Atividades Letivas

Ano Letivo	Sem.	Nome da Unidade Curricular	Curso(s)	Coord
------------	------	----------------------------	----------	-------

2026/2027	2º	Produtos Estruturados	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2026/2027	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Sim
2026/2027	1º	Dissertação em Matemática Financeira		Sim
2026/2027	1º	Trabalho de Projeto em Matemática Financeira		Sim
2026/2027	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade;	Sim
2026/2027	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2025/2026	2º	Mercados de Taxa de Juro	Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance;	Sim
2025/2026	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Sim
2025/2026	2º	Opções Exóticas		Sim
2025/2026	1º	Teoria do Risco em Seguros Não-Vida		Sim
2025/2026	1º	Dissertação em Matemática Financeira		Sim
2025/2026	1º	Trabalho de Projeto em Matemática Financeira		Sim
2025/2026	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade;	Sim
2025/2026	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2024/2025	2º	Gestão de Activos e Passivos	Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros;	Sim
2024/2025	2º	Mercados de Taxa de Juro	Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance;	Sim
2024/2025	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Sim
2024/2025	2º	Opções Exóticas		Sim
2024/2025	1º	Teoria do Risco em Seguros Não-Vida		Sim
2024/2025	1º	Dissertação em Matemática Financeira		Sim

2024/2025	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade;	Sim
2024/2025	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2023/2024	2º	Modelação Financeira		Sim
2023/2024	2º	Mercados de Taxa de Juro	Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance;	Sim
2023/2024	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Sim
2023/2024	2º	Opções Exóticas		Sim
2023/2024	1º	Teoria do Risco em Seguros Não-Vida		Sim
2023/2024	1º	Dissertação em Matemática Financeira		Sim
2023/2024	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade;	Sim
2023/2024	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2022/2023	2º	Dissertação em Matemática Financeira		Sim
2022/2023	2º	Gestão de Activos e Passivos	Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros;	Sim
2022/2023	2º	Mercados de Taxa de Juro	Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance;	Sim
2022/2023	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Sim
2022/2023	2º	Opções Exóticas		Sim
2022/2023	1º	Teoria do Risco em Seguros Não-Vida		Sim
2022/2023	1º	Dissertação em Matemática Financeira		Sim
2022/2023	1º	Investimentos II	Doutoramento em Finanças;	Não
2022/2023	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade;	Sim
2022/2023	1º	Investimentos	Mestrado em Finanças;	Não
2022/2023	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim

2021/2022	2º	Dissertação em Matemática Financeira		Sim
2021/2022	2º	Mercados de Taxa de Juro	Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance;	Sim
2021/2022	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Sim
2021/2022	2º	Opções Exóticas		Sim
2021/2022	1º	Dissertação em Matemática Financeira		Sim
2021/2022	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade;	Sim
2021/2022	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	2º	Dissertação em Matemática Financeira		Sim
2020/2021	2º	Gestão de Activos e Passivos	Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros;	Sim
2020/2021	2º	Mercados de Taxa de Juro	Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance;	Sim
2020/2021	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Sim
2020/2021	2º	Programação		Sim
2020/2021	2º	Opções Exóticas		Sim
2020/2021	2º	Cálculo Estocástico em Finanças I		Sim
2020/2021	2º	Equações com Derivadas Parciais em Finanças		Sim
2020/2021	2º	Cálculo Estocástico em Finanças II		Sim
2020/2021	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade;	Sim
2020/2021	1º	Investimentos Financeiros		Sim
2020/2021	1º	Métodos Numéricos		Não
2020/2021	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	1º	Teoria da Medida		Sim
2019/2020	2º	Dissertação em Matemática Financeira		Sim

2019/2020	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Sim
2019/2020	2º	Programação		Sim
2019/2020	2º	Opções Exóticas		Sim
2019/2020	2º	Cálculo Estocástico em Finanças I		Sim
2019/2020	2º	Equações com Derivadas Parciais em Finanças		Sim
2019/2020	2º	Cálculo Estocástico em Finanças II		Sim
2019/2020	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade;	Sim
2019/2020	1º	Investimentos Financeiros		Sim
2019/2020	1º	Métodos Numéricos		Sim
2019/2020	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	1º	Teoria da Medida		Sim

## Orientações

### • Teses de Doutoramento

#### - Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Domingos da Silva Ferreira	ANÁLISE DA PARIDADE PUT-CALL EM OPÇÕES SOBRE OS ÍNDICES DE ACÇÕES: PSI-20 E IBEX-35	Inglês	Em curso	Iscte
2	Paulo Miguel M Gama Gonçalves	A PREVISÃO DOS RETORNOS EM ACÇÕES UTILIZANDO VARIÁVEIS FUNDAMENTAIS: PORTUGAL (1989-1999)	Inglês	Em curso	Iscte
3	Rui Manuel M dos Anjos Alpalhão	NACIONALIZAÇÕES, INDEMINIZAÇÕES E PRIVATIZAÇÕES EM PORTUGAL; ANÁLISE DAS TRANSFERÊNCIAS DE RIQUEZA E REESTRUTURAÇÕES EMPRESARIAIS	Inglês	Em curso	Iscte

#### - Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
--	-------------------	---------------	--------	-------------	------------------

1	Fernando Correia da Silva	Caps, floors and collars on continuous flows and investment decisions	Inglês	Iscte	2023
2	Mário Jorge Correia Fernandes	Three Essays on Modeling Energy Prices with Time-Varying Volatility and Jumps	--	Iscte	2021
3	Pedro Miguel Silva Prazeres	Essays on Options Pricing, with Applications on Interest Rates, Equities and Credit Derivatives	--	Iscte	2017
4	João Pedro Ruas	Three Essays on the Valuation of American-style Options	Inglês	Iscte	2013
5	João Pedro Bento Ruas	Three Essays on the Valuation of American-Style Options	Inglês	Iscte	2013
6	Luís Alberto Ferreira de Oliveira	Theoretical and Empirical Essays On the Heath-jarrow-morton Framework	--	Iscte	2007
7	Paulo Miguel Marques Gama Gonçalves	Essays on International Equity Markets	Inglês	Iscte	2005

## • Dissertações de Mestrado

### - Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Dmytro Yefimenko	Joint SPX/VIX calibration through the Guyon methodology	--	Em curso	Iscte
2	Raquel Oliveira Coelho	Trabalho de Projeto	--	Em curso	Iscte
3	João Pedro Gonçalves Frazão do Rosário	A calibração conjunta SPX/VIX	--	Em curso	Iscte
4	Maria Leonor Cabral Campello Aboim de Barros	Trabalho de Projeto - Fair value de um interest rate cap	--	Em curso	Iscte

### - Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Catarina Isabel Marcos Mota	Avaliação de Opções de Barreira no Modelo de Heston utilizando o Método COS	Português	Iscte	2026
2	José Miguel Mateus Serejo Rocha das Neves	Distribuições neutras ao risco implícitas em modelos de difusão com saltos e volatilidade estocástica.	Inglês	Iscte	2025
3	Cláudio dos Santos Machado	Distribuição implícita de risco neutro: abordagem paramétrica	Inglês	Iscte	2025

4	Miguel Natal de Brito Bofo	Análise Numérica e Teórica de Lognormal e Location-Scale t Mixture Models na Extração de Densidades de Risco Neutro	Inglês	Iscte	2025
5	Sofia Barreto Baptista Basílio	Análise de Risco de Crédito de Títulos Verdes e comparação com Títulos Tradicionais	Inglês	Iscte	2025
6	Mafalda Amaro Caneira	a variância do prémio de risco	Inglês	Iscte	2024
7	André Filipe Assunção Damásio	Prémio de risco para futuros do VIX-squared sob o modelo de Eraker-Wu (2017)	Inglês	Iscte	2023
8	Ana Marisa Silva Sousa	Calibração do Modelo de Jarrow e Yildirim (2003) para a determinação do preço das obrigações TIPS	Português	Iscte	2023
9	Daniel Alexandre Velho Ferreira	Pricing na era pós-IBOR	Inglês	Iscte	2022
10	Claudio Alberto Salinas Tejerina	O SPX e o VIX saltam simultaneamente?	Inglês	Iscte	2021
11	João Luís Gomes Ferreira Campos Andrada	Modelização paramétrica da superfície de volatilidade implícita	Português	Iscte	2018
12	Ricardo Manuel Santos Oliveira Tomaz	The Market Value of Corporate Votes: Another Approach.	Inglês	Iscte	2017
13	João Miguel Sousa Machado Castilho Borges	Impacto da Política do Quantitative Easing num Portfólio de Investimento	Português	Iscte	2017
14	Inês Sofia Morais Ferreira	Opções sobre commodities	Português	Iscte	2016
15	Bruno Filipe Soares dos Santos Sousa	Credit Valuation Adjustment	Inglês	Iscte	2016
16	Ricardo Nuno Santos Aleixo de Matos	Stochastic Volatility Jump-diffusion Models us time-changed levy Processes	Inglês	Iscte	2014
17	Pedro Simões Oliveira	The corvolution method for pricing American options under levy processes	Inglês	Iscte	2014
18	Igor Viktorovich Kravchenko	Barrier Option Pricing Via Heston Model	Inglês	Iscte	2013
19	Sara Alexandra da Costa Veloso	O Modelo Fiscal de Avaliação de Prédios Urbanos e o Ciclo Económico do País	Português	Iscte	2013
20	Jorge Miguel Fernandes Nascimento	Dimensão e especificação de volatilidades e correlações para lognormal LIBOR market models: uma avaliação empírica	Inglês	Iscte	2004
21	Maria Isabel Lopes Soares	Kalman filtering of affine term structure models with macro state variables	Inglês	Iscte	2004

22	Sofia Nú Oliveira	Empirical analysis of the primary market for range notes	Inglês	Iscte	2003
23	Luís Alberto Ferreira de Oliveira	The quality option implicit in treasury bond futures contracts: a theoretical and empirical assessment	Inglês	Iscte	2002

## • Projetos Finais de Mestrado

### - Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Marta Filipa das Neves Antunes	Avaliação de um Interest Rate Cap: Metodologia, Implementação e Resultados	Português	Iscte	2025
2	Sabrina Maria Bastos Serralva	Avaliação do Fair Value de um Interest Rate Cap para a Gestão de Riscos Financeiros numa Empresa	Inglês	Iscte	2024
3	Margarida Dinis Silvestre	Pateo Wine Bar & Heritage Shop	Inglês	Iscte	2012
4	Sara Isabel Poço Ramos	Decomposição, Avaliação e Hedging de um Produto Estruturado	Português	Iscte	2012
5	Tiago Miguel Vargas Tavares	Modelos de Taxa de Juro após a Crise de Crédito e Liquidez	Português	Iscte	2012
6	Iva Bagic	Singue and Combined Option Trading Strategies.	--	Iscte	2011
7	Arne Neumann	Assembly and Preparation for the Derivative Market - A Convenience Comparison Between Financial Options and Futures with View to the Eurex and Liffe.	--	Iscte	2011
8	William Hilebrand	The Valuation of Callable Defaultable Bonds.	--	Iscte	2011
9	Luís Filipe Dôres Veiga	--	--	Iscte	2011
10	Jorge Alexandre Rodrigues Domingues	--	--	Iscte	2011
11	Filipa Isabel Ferreira Alcaide	Covered Bond Market - Is Legislation Impact Measurable?	Inglês	Iscte	2011
12	Maria da Graça Teixeira Duarte de Aguiar Câmara	O Efeito Smile - Uma Aplicação ao DAX.	Português	Iscte	2010
13	Diogo Monteiro da Costa Soares Justino	Hedging of Barrier Options.	Português	Iscte	2010
14	Cláudia Patrícia Gonçalves Simões	Euro Área Inflation-Linked Bonds Market: Analysis and immunization abilities.	Português	Iscte	2010

15	Aloísio Bragança Gomes Will	Ambidiesel - Produção de Combustíveis Alternativos.	Português	Iscte	2010
16	Carina Sofia Ferreira da Silva	O Mercado Organizado de CO2 - Oportunidade de Investimento e Melhoria do Ambiente Compatíveis?	Português	Iscte	2009
17	Fernando Manuel de Deus Infante	Basileia II: Análise das Implicações do Pilar 2 na Organização do Processo de Supervisão.	Português	Iscte	2009

## Total de Citações

<b>Web of Science®</b>	374
<b>Scopus</b>	292

## Publicações

### • Revistas Científicas

#### - Artigo em revista científica

1	Dias, J. C., Nunes, J. P. V., Ruas, J. P. & Silva, F. C. da. (2026). Optimal investment decisions with minimum price guarantees under the constant elasticity of variance process. Omega. 143
2	Dias, J. C., Nunes, J. P. V. & Silva, F. (2024). Novel analytic representations for caps, floors, collars, and exchange options on continuous flows, arbitrage-free relations, and optimal investments. Journal of Futures Markets. 44 (12), 1869-1887 - N.º de citações Web of Science®: 2 - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 5
3	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. (2024). Finite maturity caps and floors on continuous flows under the constant elasticity of variance process. European Journal of Operational Research . 316 (1), 361-385 - N.º de citações Web of Science®: 6 - N.º de citações Scopus: 4 - N.º de citações Google Scholar: 10
4	Glória, C. M., Dias, J. C., Ruas, J. P. & Nunes, J. P. V. (2024). The interaction between equity-based compensation and debt in managerial risk choices. Review of Derivatives Research. 27 (3), 227-258 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 1
5	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2024). Performance comparison of alternative stochastic volatility models and its determinants in energy futures: COVID19 and Russia-Ukraine conflict features. Journal of Futures Markets. 44 (3), 343-383 - N.º de citações Web of Science®: 3 - N.º de citações Scopus: 3 - N.º de citações Google Scholar: 5

6	<p>Nunes, J. &amp; Ruas, J. (2024). A note on the Gumbel convergence for the Lee and Mykland jump tests. <i>Finance Research Letters</i>. 59</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 2</p> <p>- N.º de citações Scopus: 2</p>
7	<p>Bravo, J. M. &amp; Nunes, J. (2021). Pricing longevity derivatives via Fourier transforms. <i>Insurance: Mathematics and Economics</i>. 96, 81-97</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 41</p> <p>- N.º de citações Scopus: 28</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 69</p>
8	<p>Fernandes, M. C, Dias, J. C. &amp; Nunes, J. (2021). Modeling energy prices under energy transition: A novel stochastic-copula approach. <i>Economic Modelling</i> . 105</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 15</p> <p>- N.º de citações Scopus: 16</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 20</p>
9	<p>Nunes, J., Ruas, J. &amp; Dias, J. C. (2020). Early exercise boundaries for American-style knock-out options. <i>European Journal of Operational Research</i> . 285 (2), 753-766</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 12</p> <p>- N.º de citações Scopus: 9</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 15</p>
10	<p>Dias, J. C., Nunes, J. &amp; Cruz, A. (2020). A note on options and bubbles under the CEV model: Implications for pricing and hedging. <i>Review of Derivatives Research</i>. 23 (3), 249-272</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 9</p> <p>- N.º de citações Scopus: 7</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 15</p>
11	<p>Nunes, J. P. V., Dias, J. C. &amp; Ruas, J. P. (2020). The early exercise boundary under the jump to default extended CEV model. <i>Applied Mathematics and Optimization</i>. 82 (1), 151-181</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 2</p> <p>- N.º de citações Scopus: 2</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 6</p>
12	<p>Dias, J. C. &amp; Nunes, J. P. V. (2018). Universal recurrence algorithm for computing Nuttall, generalized Marcum and incomplete Toronto functions and moments of a noncentral <math>x_2</math> random variable. <i>European Journal of Operational Research</i> . 265 (2), 559-570</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 5</p> <p>- N.º de citações Scopus: 3</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 8</p>
13	<p>Ruas, J. P., Nunes, J. P. V. &amp; Dias, J. C. (2016). In-out parity relations for American-style barrier options. <i>Journal of Derivatives</i>. 23 (4), 20-32</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 1</p> <p>- N.º de citações Scopus: 1</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 2</p>
14	<p>Nunes, J. P. V. &amp; Alcária, T. R. V. (2016). Valuation of forward start options under affine jump-diffusion models. <i>Quantitative Finance</i>. 16 (5), 727-747</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 3</p> <p>- N.º de citações Scopus: 2</p>

15	<p>Dias, J. C., Nunes, J. P. V. &amp; Ruas, J. P. (2015). Pricing and static hedging of european-style double barrier options under the jump to default extended CEV model. <i>Quantitative Finance</i>. 15 (12), 1995-2010</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 21</li> <li>- N.º de citações Scopus: 14</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 26</li> </ul>
16	<p>Nunes, J., Ruas, J. &amp; Dias, J. C. (2015). Pricing and static hedging of American-style knock-in options on defaultable stocks. <i>Journal of Banking and Finance</i>. 58, 343-360</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 23</li> <li>- N.º de citações Scopus: 15</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 26</li> </ul>
17	<p>Nunes, J. &amp; Prazeres, P. (2014). Pricing swaptions under multifactor gaussian HJM models. <i>Mathematical Finance</i>. 24 (4), 762-789</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 4</li> <li>- N.º de citações Scopus: 4</li> </ul>
18	<p>Oliveira, L., Nunes, J. &amp; Malcato, L. (2014). The performance of deterministic and stochastic interest rate risk measures: another question of dimensions?. <i>Portuguese Economic Journal</i>. 13 (3), 141-165</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 5</li> <li>- N.º de citações Scopus: 5</li> </ul>
19	<p>Ruas, J. P., Dias, J. C. &amp; Nunes, J. (2013). Pricing and static hedging of American-style options under the jump to default extended CEV model. <i>Journal of Banking and Finance</i>. 37 (11), 4059-4072</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 32</li> <li>- N.º de citações Scopus: 20</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 38</li> </ul>
20	<p>Oliveira, L., Curto, J. D. &amp; Nunes, J. P. (2012). The determinants of sovereign credit spread changes in the Euro-zone. <i>Journal of International Financial Markets, Institutions &amp; Money</i>. 22 (2), 278-304</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 76</li> <li>- N.º de citações Scopus: 64</li> </ul>
21	<p>Dias, J. C. &amp; Nunes, J. P. (2011). Pricing real options under the constant elasticity of variance diffusion. <i>Journal of Futures Markets</i>. 31 (3), 230-250</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 38</li> <li>- N.º de citações Scopus: 31</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 56</li> </ul>
22	<p>Nunes, J. P. V. (2011). American options and callable bonds under stochastic interest rates and endogenous bankruptcy. <i>Review of Derivatives Research</i>. 14 (3), 283-332</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 5</li> <li>- N.º de citações Scopus: 2</li> </ul>
23	<p>Nunes, J. (2009). Pricing American Options under the Constant Elasticity of Variance Model and Subject to Bankruptcy. <i>Journal of Financial and Quantitative Analysis</i>. 44, 1231-1263</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 44</li> <li>- N.º de citações Scopus: 34</li> </ul>
24	<p>Nunes, J. P. V. &amp; Oliveira, L. (2007). Multifactor and analytical valuation of treasury bond futures with an embedded quality option. <i>Journal of Futures Markets</i>. 27 (3), 275-303</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 8</li> </ul>
25	<p>Nunes, J. P. V. (2006). Barrier options on spot LIBOR rates under multi-factor Gaussian HJM models. <i>Journal of Derivatives</i>. 14 (1), 61-81</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Scopus: 3</li> </ul>

26	Nunes, J. P. V. (2004). Multifactor valuation of floating range notes. <i>Mathematical Finance</i> . 14 (2), 79-97 - N.º de citações Web of Science®: 16 - N.º de citações Scopus: 13
27	Nunes, J. P. V. (2004). A general equilibrium framework for the affine class of term structure models. <i>Portuguese Economic Journal</i> . 3 (1), 15-48
28	Nunes, J., Clewlow, L. & Hodges, S. (1999). Interest Rate Derivatives in a Duffie and Kan Model with Stochastic Volatility: An Arrow-Debreu Pricing Approach. <i>Review of Derivatives Research</i> . 3, 5-66 - N.º de citações Scopus: 8
29	Nunes, J. (1998). Interest Rate Options in a Duffie-Kan Model with Deterministic Volatility. <i>Portuguese Review of Financial Markets</i> . 1, 63-101

## • Livros e Capítulos de Livros

### - Autor de livro

1	Miguel, A., Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Lourenço, J., Oliveira, L....Alpalhão, R. (2019). <i>Investimentos Financeiros - Teoria e Prática</i> . Lisboa. Silabo.
2	Barroso, C., Mota, A., Oliveira, L., Nunes, J. & Inácio, P. (2015). <i>Finanças da Empresa: Teoria e Prática (edição revista e aumentada)</i> . Lisboa. Silabo.
3	Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Oliveira, L., Ferreira, M. & Inácio, P. (2015). <i>Finanças da Empresa: Teoria e Prática</i> . Lisboa. Sílabo.
4	Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Oliveira, L. & Ferreira, M. (2012). <i>Investimentos Financeiros: teoria e prática</i> . Portugal . Edições Sílabo .
5	Barroso, C., Mota, A., Nunes, J. & Ferreira, M. (2012). <i>Finanças da Empresa - Teoria e Prática</i> . Lisboa. Edições Silabo.
6	Barroso, C., Mota, A., Nunes, J. & Ferreira, M. (2010). <i>Finanças da Empresa _ Teoria e Prática</i> . Edições Silabo.
7	Oliveira, L., Mota, A., Barroso, C. & Nunes, J. (2009). <i>Investimentos Financeiros: Teoria e prática</i> . Lisboa/Portugal. Edições Sílabo.

### - Editor de livro

1	Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Miguel A. Ferreira & Oliveira, L. (2012). <i>Finanças da Empresa: Teoria e Prática</i> . Lisboa/Portugal. Sílabo.
2	Oliveira, L., Barroso, C., Nunes, J. & Miguel A. Ferreira (2011). <i>Finanças da Empresa Teoria e Prática</i> . Portugal. Sílabo.

## • Outras Publicações

### - Artigo sem avaliação científica

1	Oliveira, L. & Nunes, J. (2012). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. SSRN. 0-0
2	Oliveira, L. & Nunes, J. (2008). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures . SSRN. 0-0
3	Nunes, J. (1994). Gestão dos Riscos de Taxa de Juro e de Câmbio. Revista da Aula do Comércio. 15, 10-13
4	Mota, A. & Nunes, J. (1993). Avaliação de Aplicações Financeiras de Curto Prazo. Revista Iscte Gestão. 1, 13-15
5	Nunes, J. (1991). Indexante FIP versus Taxas APB. Revista de Gestão. 10, 23-27

#### - Outras publicações

1	Ruas, J., Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Erratum to “Pricing and static hedging of American-style options under the jump to default extended CEV model” (Journal of Banking and Finance (2013) 37(11) (4059–4072) (S0378426613002896) (10.1016/j.jbankfin.2013.07.019)). Journal of Banking and Finance. 81, 20-23
2	Nunes, J., Pereira da Silva, C. & Cadete, J. (2003). The Immunisation of a Workers' Compensation Fund. Bulletin of the Portuguese Institute of Actuaries. 42, 11-39

### • Conferências/Workshops e Comunicações

#### - Comunicação em evento científico

1	Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2025). Unpuzzling Volatility Risk Premiums through the Joint SPX/VIX Smile Calibration. Workshop on Financial Risk with Big Data.
2	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. (2024). Novel Analytic Representations for Caps, Floors and Collars on Continuous Flows, Arbitrage-Free Relations and Optimal Investments. 33rd European Financial Management Association (EFMA).
3	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2023). The Behaviour of Stochastic Volatility in Energy Futures Contracts with the COVID- 19 and the Russia–Ukraine Conflict. 12th International Conference of the Financial Engineering and Banking Society.
4	Dias, J. C., Nunes, J., Ruas, J. & Silva, F. C. (2023). Optimal Investment Decisions with Minimum Price Guarantees under the Constant Elasticity of Variance Process. 26th International Conference on Real Options.
5	Dias, J. C., Nunes, J., Ruas, J. & Silva, F. C. (2023). Optimal Investment Decisions with Minimum Price Guarantees under the Constant Elasticity of Variance Process. 12th International Conference of the Portuguese Finance Network.
6	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. C. (2022). Finite Maturity Caps and Floors on Continuous Flows under the CEV Process. Informs Annual Meeting.
7	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. C. (2022). Finite Maturity Caps and Floors on Continuous Flows under the CEV Process. 19th EUROPT Workshop on Advances in Continuous Optimization.
8	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2022). Modeling Energy Futures Prices Under Alternative Time-Varying Volatility Dynamics. 29th Annual Global Finance Conference.

9	Gloria, C. M., Dias, J. C., Ruas, J. & Nunes, J. (2022). The Interaction Between Equity-Based Compensation and Debt in Managerial Risk Choices. Paris Financial Management Conference.
10	Dias, J. C., Ildefonso, J., Nunes, J. & Ruas, J. (2021). Repeated Richardson Extrapolation and Static Hedging of Barrier Options under the JDCEV Model. 11th International Conference of the Portuguese Finance Network.
11	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2021). Modeling Electricity and Natural Gas Prices under the Electrification of Energy Firms. 14th Annual Meeting of the Portuguese Economic Journal.
12	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2021). Modeling Commodity Prices under Alternative Jump Processes and Fat Tails Dynamics. 11th International Conference of the Portuguese Finance Network.
13	Dias, J. C. & Nunes, J. (2018). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 12th Workshop on Statistics, Mathematics and Computation.
14	Dias, J. C. & Nunes, J. (2018). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 10th International Conference of the Portuguese Finance Network.
15	Ruas, J., Nunes, J. & Dias, J. C. (2018). Early Exercise Boundaries for American-style Knock-Out Options. 10th World Congress of the Bachelier Finance Society.
16	Dias, J. C., Laureano, L. & Nunes, J. (2017). Corporate Security Valuation under a Barrier Option Framework with State-Dependent Volatility. 5th Paris Financial Management Conference.
17	Leite, J., Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Computation of Three Discrete Distribution Mixtures of Continuous Distributions: Stability Analysis. 11th International Conference on Computational and Financial Econometrics.
18	Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. XXIII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
19	Leite, J., Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Cálculo Computacional de Misturas Discretas de Distribuições Contínuas: Revisão do Método de Benton e Krishnamoorthy. XXIII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
20	Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 2nd International Conference on Computational Finance.
21	Dias, J. C. & Nunes, J. (2016). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 9th World Congress of the Bachelier Finance Society.
22	Nunes, J., Dias, J. C. & Ruas, J. (2016). The Early Exercise Boundary under the Jump to Default Extended CEV Model. 9th World Congress of the Bachelier Finance Society.
23	Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2014). Static Hedging and Early Exercise Boundaries for American-style Barrier Options. 8th World Congress of the Bachelier Finance Society.
24	Dias, J. C., Nunes, J. & Ruas, J. (2014). Pricing and Static Hedging of American-style Double Knock-In Options. Mathematical Finance Workshop: Stochastic Analysis and Numerical Approximations in Mathematical Finance.
25	Dias, J. C., Nunes, J. & Ruas, J. (2014). Pricing and Static Hedging of European-style Double Barrier Options under the Jump to Default Extended CEV Model. 8th International Conference of the Portuguese Finance Network.

26	Nunes, J. & Oliveira, L. (2013). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. 7th Annual Meeting of the Portuguese Economic Journal.
27	Dias, J.C., Nunes, J.P. & Ruas, J. P. (2013). In-Out Parity Relations and Early Exercise Boundaries for American-Style Barrier Options. FMA 17th European Conference.
28	Nunes, J. & Oliveira, L. (2013). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. FMA Europe 2013 Meeting.
29	Dias, J.C., Nunes, J.P. & Ruas, J. P. (2013). Pricing and Static Hedging of American Options under the Jump to Default Extended CEV Model. FMA 17th European Conference.
30	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. Mathematical Finance Days Conference.
31	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). Pricing Double Barrier Options under the CEV Process: A Speed-Accuracy Comparison of Alternative Methods. 7th World Congress of the Bachelier Finance Society.
32	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. 7th International Conference of the Portuguese Finance Network.
33	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. SIAM Conference on Financial Mathematics & Engineering.
34	Nunes, J. & Prazeres, P. (2012). Pricing Swaptions under Multifactor Gaussian HJM Models. Mathematical Finance Days 2012 Meeting.
35	Nunes, J. & Ruas, J. (2012). The Implied Volatility Bias: A No-Arbitrage Approach for Short-Dated Options. EFMA 2012 Meeting.
36	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). Truncated Moments of a Noncentral $\chi^2$ Random Variable: An Extension of the Benton and Krishnamoorthy Approach. XX Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
37	Nunes, J. & Prazeres, P. (2012). Pricing Swaptions under Multifactor Gaussian HJM Models. SIAM Conference on Financial Mathematics and Engineering.
38	Dias, J.C., Nunes, J.P. & Ruas, J. P. (2012). Pricing and Static Hedging of American Options under the Jump to Default Extended CEV Model. INFORMS Annual Meeting.
39	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2011). Double Barrier Options Valuation under Multifactor Pricing Models. 21st Annual Derivatives Securities and Risk Management Conference.
40	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2011). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. International Conference on Mathematical Finance and Economics.
41	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2010). Double Barrier Options Valuation under Multifactor Pricing Models. 6th World Congress of the Bachelier Finance Society.
42	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2008). Pricing Real Options under the CEV Diffusion. 12th International Conference on Real Options.

43	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2008). Pricing Real Options under the CEV Diffusion. 5th International Conference of the Portuguese Finance Network.
----	--

## Cargos de Gestão Académica

Membro (Docente) (2025 - 2029)  
Unidade/Área: Conselho Geral

Director (2025 - 2027)  
Unidade/Área: Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)

Membro (Docente) (2023 - 2025)  
Unidade/Área: Plenário do Conselho Científico

Director (2023 - 2025)  
Unidade/Área: Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)

Coordenador (2022 - 2023)  
Unidade/Área: Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros

Membro (Docente) (2021 - 2023)  
Unidade/Área: Conselho Geral

Coordenador (2021 - 2025)  
Unidade/Área: Grupo de Finanças

Director (2021 - 2023)  
Unidade/Área: Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)

Coordenador (2021)  
Unidade/Área: Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance

Coordenador (2020 - 2021)  
Unidade/Área: Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros

Director (2019 - 2021)  
Unidade/Área: Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)

Membro (Docente) (2018 - 2022)  
Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica

Membro (Docente) (2018 - 2022)  
Unidade/Área: Comissão Científica

Coordenador (2018 - 2021)  
Unidade/Área: Grupo de Finanças

Membro (2017 - 2021)  
Unidade/Área: Conselho Geral

Director (2017 - 2019)  
Unidade/Área: Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)

Coordenador de ECTS (2015 - 2018)  
Unidade/Área: Departamento de Finanças

Director (2015 - 2017)  
Unidade/Área: Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)

Sub-diretor (2014 - 2018)  
Unidade/Área: Departamento de Finanças

Membro (Docente) (2014 - 2018) Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica
Membro (Docente) (2014 - 2018) Unidade/Área: Comissão Científica
Director (2013 - 2015) Unidade/Área: Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)
Coordenador de ECTS (2012 - 2015) Unidade/Área: Departamento de Finanças
Director (2011 - 2013) Unidade/Área: [BPG004] Mercados e Activos Financeiros
Director (2011 - 2013) Unidade/Área: Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)
Membro (Docente) (2010 - 2014) Unidade/Área: Plenário do Conselho Científico
Director (2010 - 2011) Unidade/Área: [BPG004] Mercados e Activos Financeiros
Director (2010 - 2011) Unidade/Área: Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)
Presidente (2010 - 2014) Unidade/Área: Comissão Científica
Director (2010 - 2014) Unidade/Área: Departamento de Finanças
Membro (Docente) (2010 - 2014) Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica
Membro (Docente) (2010 - 2014) Unidade/Área: Comissão Científica